

英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混  
合型发起式基金中基金（FOF）  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 本报告期投资基金情况.....	44
7.13 投资组合报告附注.....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	50
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.9 其他重大事件.....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
基金简称	英大延福养老目标 2040 三年持有混合发起（FOF）
基金主代码	016666
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 28 日
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	52,175,194.53 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，依据下滑曲线进行大类资产战略配置和战术调整，追求养老资产的长期稳健增值，力争为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、基金精选策略；3、股票投资策略；4、固定收益类资产投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×A%+中债综合全价（总值）指数收益率×（1-A%）。 A%为下滑曲线权益类资产中枢占比。 其中 A%的取值如下： 时间段 A% （1-A%） 基金合同生效之日至 2025 年 12 月 31 日 50% 50% 2026 年 1 月 1 日至 2028 年 12 月 31 日 48% 52% 2029 年 1 月 1 日至 2031 年 12 月 31 日 45% 55% 2032 年 1 月 1 日至 2034 年 12 月 31 日 39% 61% 2035 年 1 月 1 日至 2037 年 12 月 31 日 31% 69% 2038 年 1 月 1 日至 2040 年 12 月 31 日 20% 80% 目标日期（2040 年 12 月 31 日）之后 15% 85%
风险收益特征	本基金为混合型目标日期基金中基金（FOF），随着目标日期期限的接近，权益类投资比例逐渐下降，风险与收益水平会逐步降低。本基金预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、货币型基金中基金（FOF）、债券型基金和债券型基金中基金（FOF），低于股票型基金和股票型基金中基金（FOF）。 本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	英大基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 姓名	刘康喜	朱萍

负责人	联系电话	010-59112026	021-31888888
	电子邮箱	liukx@ydamc.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-890-5288	95528
传真		010-59112222	021-63602540
注册地址		北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201	上海市中山东一路 12 号
办公地址		北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		100020	200126
法定代表人		范育晖	郑杨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ydamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	英大基金管理有限公司	北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	411,077.62
本期利润	60,682.44
加权平均基金份额本期利润	0.0012
本期加权平均净值利润率	0.12%
本期基金份额净值增长率	0.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	142,853.46
期末可供分配基金份额利润	0.0027
期末基金资产净值	52,318,047.99
期末基金份额净值	1.0027
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.27%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

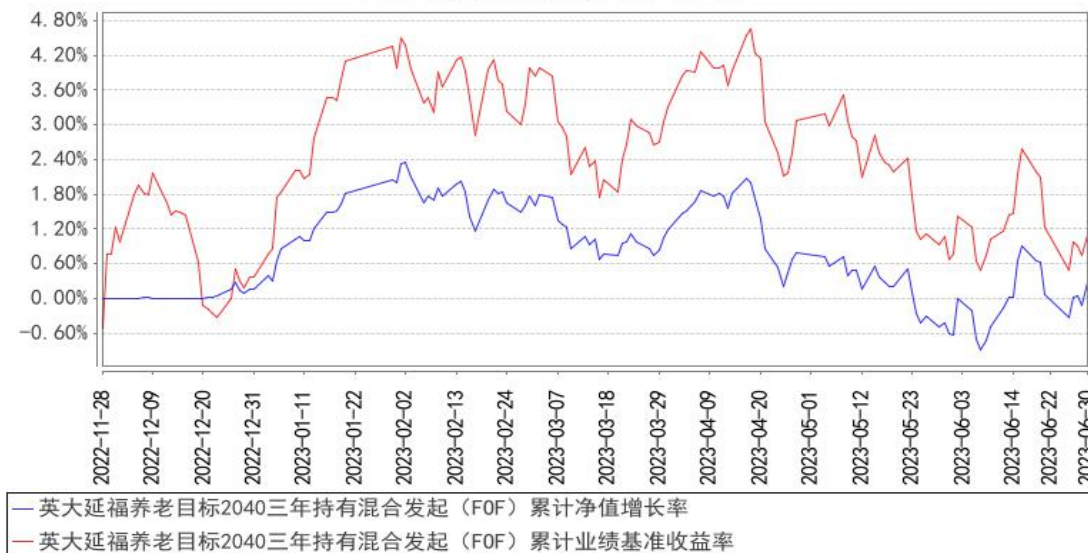
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.89%	0.34%	0.42%	0.43%	0.47%	-0.09%
过去三个月	-0.91%	0.27%	-2.14%	0.40%	1.23%	-0.13%
过去六个月	0.11%	0.24%	0.72%	0.40%	-0.61%	-0.16%
自基金合同生效起至今	0.27%	0.22%	1.09%	0.41%	-0.82%	-0.19%

注：同期业绩比较基准为中证 800 指数收益率×A%+中债综合全价（总值）指数收益率×（1-A）%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

英大延福养老目标2040三年持有混合发起 (FOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的业绩比较基准为：1. 中证 800 指数收益率×A%+中债综合全价（总值）指数收益率×（1-A）%。

2. 本基金合同生效日为 2022 年 11 月 28 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

3. 本基金建仓期为本基金合同生效之日起六个月内，截止报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

英大基金管理有限公司(以下简称“英大基金”)成立于 2012 年 8 月 17 日,注册资本金 11.46 亿元,是国网英大国际控股集团有限公司的全资子公司,实际控制人为国家电网有限公司。英大基金依托股东优势,坚持市场化发展方向,立足新发展阶段、贯彻新发展理念,根植主业、服务实业、坚持能源特色、努力创造价值,积极构建规模、速度、结构、质量、效益、安全“六统一”的新发展格局,致力于为客户提供卓越的资产管理服务。

截至 2022 年末,公司全口径管理资产规模站稳千亿平台,主动管理能力与业务规模同步提升。公司依托高效的决策机制、专业的投研团队、严谨的风控体系,先后荣获东方财富风云榜“最具潜力基金公司奖”、金融界领航中国“金智奖”之“杰出新锐基金公司”、新浪财经“最具成长潜力基金公司”,在 2023 金融业高质量发展大会暨第九届金融企业社会责任论坛上,公司以“深化普惠金融,助力共同富裕”的一系列实践获评《金融企业社会责任蓝皮书(2022)》优秀案例等奖项。

截至 2023 年 6 月 30 日,本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金、英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金、英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大通佑纯债一年定期开放债券型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、英大安昞纯债债券型证券投资基金、英大碳中和混合型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、英大延福养老目标日期 2055 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、英大延福养老目标日期 2060 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF) 26 只开放式证券投资基金,同时,管理数十个特定客户资产投资组合。



基金管理人与股东之间实行业务隔离制度，股东并不直接参与基金财产的投资运作。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申恒亮	本基金的基金经理	2022 年 11 月 28 日	-	13 年	青岛大学经济学硕士。2004 年 7 至 2005 年 7 月就职于青岛市中迪宏绩工贸有限公司，任产品设计员；2008 年 7 月至 2010 年 7 月就职于天相投资顾问有限公司，任研究员；2010 年 7 月至 2011 年 8 月就职于盈融达投资（北京）有限公司，任研究员；2011 年 8 月至 2015 年 4 月就职于恒泰证券股份有限公司，任投资主办人；2015 年 4 月至 2017 年 3 月就职于中邮证券有限责任公司，任权益类投资总监。2017 年 3 月加入英大基金管理有限公司，历任公司权益投资部专户投资经理，专户投资部专户投资总监，研究发展部高级研究员，权益投资部总经理助理，专户投资部总经理助理，英大资本轮值总经理，英大资本投资经理，研究发展部合规管理、总经理助理。现任英大延福养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2055 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2060 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。

注：1. 上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》、《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无

损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等国家法律法规和监管部门的规定，公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》，适用于公司所管理的全部公募基金、私募资产管理计划等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括：实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制，明确各自的投资权限，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，交易执行部门与投资决策部门严格分离，业绩与风险评估以数量分析为基础，对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程，明确投资各环节的业务职责，防范投资风险。所有投资组合共享统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、特定客户资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括：建立交易分配公平的内部控制流程，将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，以技术措施保障公平交易的实现。

风险管理部定期对不同投资组合（尤其是同一位投资经理管理的不同投资组合）在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1日内、3日内、5日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在违反公平交易原则的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国内股票市场整体呈现先扬后抑的走势，1 月份市场出现明显的上涨行情，但 2 月

份以后开始震荡调整。各大指数涨跌互现、分化较大，其中上证指数上涨 3.65%、深证成指上涨 0.10%、创业板指下跌 5.61%。从行业表现来看通信和传媒涨幅居前、商贸零售及房地产跌幅较大。恒生指数与 A 股表现趋同，下跌 4.37%。美股表现强劲，其中纳斯达克指数上涨 31.73%。债券资产方面，国内债券持续上涨。商品方面，黄金震荡上行、5 月份创出阶段性新高后回落，原油持续下跌。汇率方面，人民币对美元持续贬值。

报告期内本基金投资策略以稳健运作为主。资产配置方面，为了应对市场的震荡调整，我们将权益类资产配置比例控制在 45% 以内，维持在中枢值以下。基金配置方面，主动管理型基金主要是长期业绩优秀，持仓行业相对分散的基金。被动型基金一部分配置宽基 ETF，一部分配置行业 ETF。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0027 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.11%，业绩比较基准收益率为 0.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据国家统计局发布经济数据，上半年国内生产总值 593034 亿元。分季度看，一季度国内生产总值同比增长 4.5%，二季度增长 6.3%，从环比看，二季度国内生产总值增长 0.8%。我国经济正处于恢复性增长阶段，经济运转逐步向正常轨道回归。

展望下半年，我国经济有望继续复苏，完成全年 5% 增长目标的可能性较大。从政策来看，稳健的货币政策将延续、积极的财政政策有可能进一步加码。随着经济的恢复，国内股票市场也有望回暖。从估值角度来看，目前 A 股平均 PE、PB 已处于历史偏低位置，下跌空间相对有限；从业绩角度来看，上市公司整体盈利情况有望继续好转。我们将根据市场情况，择机加大权益类资产的配置比例，可能会达到中枢值以上。当然，宏观经济和资本市场仍然存在各种不确定性因素、各个行业之间仍会出现比较大的分化，我们会继续审慎的进行投资运作。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以电子形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以电子签名形式返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资

总监、运营分管领导及基金运营部、监察稽核部、风险管理部的负责人及其他根据议题需要指定的相关人员；委员会秘书由基金运营部负责人担任。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人无应说明预警信息。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由英大基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	910,678.83	6,998,596.89
结算备付金		300,980.84	-
存出保证金		10,903.20	-
交易性金融资产	6.4.7.2	48,598,709.58	31,794,144.32
其中：股票投资		-	-
基金投资		45,582,920.54	31,794,144.32
债券投资		3,015,789.04	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,599,009.86	10,003,797.25
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,485.21	4,020,000.00
应收股利		525.98	756.27
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	29.40	176.44
资产总计		52,422,322.90	52,817,471.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	503,720.15
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,953.35	16,006.37
应付托管费		6,397.20	6,646.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	73,924.36	50,000.00
负债合计		104,274.91	576,373.47
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	52,175,194.53	52,159,072.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	142,853.46	82,025.67
净资产合计		52,318,047.99	52,241,097.70
负债和净资产总计		52,422,322.90	52,817,471.17

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0027 元，基金份额总额 52,175,194.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		319,859.23
1. 利息收入		62,414.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	17,812.81
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		44,601.98
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		607,577.46
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益	6.4.7.15	391,082.44
债券投资收益	6.4.7.16	1,741.09
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	214,753.93
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-350,395.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	262.16
<b>减：二、营业总支出</b>		259,176.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	140,945.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,126.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		1,504.71
8. 其他费用	6.4.7.25	77,599.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		60,682.44
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		60,682.44
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		60,682.44

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	52,159,072.03	-	82,025.67	52,241,097.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	52,159,072.03	-	82,025.67	52,241,097.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	16,122.50	-	60,827.79	76,950.29
（一）、综合收益总额	-	-	60,682.44	60,682.44
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	16,122.50	-	145.35	16,267.85
其中：1. 基金申购款	16,122.50	-	145.35	16,267.85
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	52,175,194.53	-	142,853.46	52,318,047.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

范育晖	岳喜伟	李婷
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可〔2022〕1887 号《关于准予英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 注册的批复》核准, 由英大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 52,159,016.53 元, 业经毕马威华珍会计师事务所 (特殊普通合伙) 毕马威华振验字第 2201402 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2022 年 11 月 28 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 52,159,072.03 份基金份额, 其中认购资金利息折合 55.50 份基金份额。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司, 基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金为发起式基金, 发起资金认购部分为 52,076,992.75 份基金份额, 发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金 (含商品基金 (包括但不限于商品期货基金和黄金 ETF)、香港互认基金、QDII 基金及其他经中国证监会核准或注册的基金)、国内依



法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、证券公司短期公司债券、资产支持证券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、通知存款以及定期存款等其他银行存款）、货币市场工具以及中国证监会允许基金中基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不投资于股指期货、国债期货及股票期权等衍生类金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

目标日期到期日前本基金的投资组合比例为：中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含商品基金（包括但不限于商品期货基金和黄金 ETF）、香港互认基金、QDII 基金及其他经中国证监会核准或注册的基金）占基金资产的比例不低于 80%，其中，投资于股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金和商品基金（包括但不限于商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计原则上不超过 60%（2040 年 12 月 31 日以后则合计原则上不高于基金资产的 25%），对商品基金投资占基金资产的比例不超过 10%。本基金投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

权益类资产指股票（含存托凭证）、股票型基金和混合型基金，权益类资产中的混合型基金包含以下两类：（1）基金合同中明确规定股票资产占基金资产比例为 60% 以上的混合型基金；（2）根据定期报告，最近四个季度末股票资产占基金资产比例均在 60% 以上的混合型基金。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率  $\times$  A% + 中债综合全价（总值）指数收益率  $\times$  (1-A)%。A% 为下滑曲线权益类资产中枢占比。其中自基金合同生效之日至 2025 年 12 月 31 日，A% 的值为 50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证

券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况及 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资、基金投资及债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金

额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产的商业模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。商业模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于

其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失,是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失,是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额,即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时,本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失,是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失,是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月,则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失,是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款,本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外,本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备,对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险;或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化,本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失,由此形成的损失准备的增加或转回金额,应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产,损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回,则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是,被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的,作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计

算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(未弥补亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入是按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人

不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部, 以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作, 不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况, 本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》, 根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》, 在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”), 在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外), 采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。



#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日(含)以后,管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1

月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	910,678.83
等于：本金	910,421.22
加：应计利息	257.61
减：坏账准备	-

定期存款	
等于：本金	
加：应计利息	
减：坏账准备	
其中：存款期限 1 个月以内	
存款期限 1-3 个月	
存款期限 3 个月以上	
其他存款	
等于：本金	
加：应计利息	
减：坏账准备	
合计	910,678.83

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,004,880.00	11,289.04	3,015,789.04	-380.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,004,880.00	11,289.04	3,015,789.04	-380.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	45,817,548.96	-	45,582,920.54	-234,628.42	
其他	-	-	-	-	
合计	48,822,428.96	11,289.04	48,598,709.58	-235,008.42	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本年末未持有任何衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末，本基金未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,599,009.86	-
银行间市场	-	-
合计	2,599,009.86	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本期未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未发生债权投资减值准备计提情况。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末，本基金无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期末，本基金未发生其他债权投资减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末，本基金无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未进行其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	29.40
待摊费用	-
合计	29.40

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提_信息披露费	39,671.58
预提_审计费	29,752.78
预提_中债登账户维护费	4,500.00
合计	73,924.36

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	52,159,072.03	52,159,072.03
本期申购	16,122.50	16,122.50
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	52,175,194.53	52,175,194.53

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-33,361.09	115,386.76	82,025.67
本期利润	411,077.62	-350,395.18	60,682.44
本期基金份额交易产生的变动数	104.07	41.28	145.35
其中：基金申购款	104.07	41.28	145.35
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	377,820.60	-234,967.14	142,853.46

注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		15,236.57
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		2,523.74
其他		52.50
合计		17,812.81

注：其他指结算保证金利息收入。

### 6.4.7.14 股票投资收益

#### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本报告期，本基金无股票投资收益。

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期，本基金无股票投资收益-买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出/赎回基金成交总额		20,314,476.10
减：卖出/赎回基金成本总额		19,898,567.26
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额		12,539.21
减：交易费用		12,287.19
基金投资收益		391,082.44

### 6.4.7.16 债券投资收益

#### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
债券投资收益——利息收入		1,741.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-

合计	1,741.09
----	----------

#### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期, 本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本期末未持有资产支持证券。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期, 本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期, 本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期, 本基金无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期, 本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期, 本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期, 本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期, 本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期, 本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	214,753.93
合计	214,753.93

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-350,395.18
股票投资	-
债券投资	-380.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-350,015.18
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-350,395.18

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	262.16
合计	262.16

## 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	262.16
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	121,165.77
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	25,817.21



#### 6.4.7.24 信用减值损失

本报告期，本基金未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	275.20
乙类账户维护费	7,500.00
其他	400.00
合计	77,599.56

#### 6.4.7.26 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
英大基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

### 6.4.10.1.4 基金交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

### 6.4.10.1.5 权证交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本报告期，本基金无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	140,945.76
其中：支付销售机构的客户维护费	234.38

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,126.76

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金合同生效日（2022 年 11 月 28 日）持有的基金份额	51,999,500.00
报告期初持有的基金份额	51,999,500.00	
报告期间申购/买入总份额	-	
报告期间因拆分变动份额	-	
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	
报告期末持有的基金份额	51,999,500.00	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	99.6600%	

注：报告期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；报告期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	910,678.83	15,236.57

注：本基金通过“浦发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2023 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 311,884.04 元。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

项目	本期费用
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费 (元)	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	262.16
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	7,868.92
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	2,360.74

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期无利润分配事项。

**6.4.12 期末 (2023 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末，未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

于本报告期末，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本报告期末，本基金未持有交易所市场正回购交易中作为质押的债券。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金期末未参与转融通证券出借业务。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常

的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，建立债券投资库，同时追踪持仓债券发行人的相关风险事件，以控制可能出现的信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金流动性受限资产比例、持仓集中度等指标进行持续的监测和分析。

本基金持有单只基金的市值，不超过基金资产净值的 20%，本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金在报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	910,678.83	-	-	-	-	-	910,678.83
结算备付金	300,980.84	-	-	-	-	-	300,980.84
存出保证金	10,903.20	-	-	-	-	-	10,903.20
交易性金融资产	-	-	3,015,789.04	-	-	45,582,920.54	48,598,709.58
买入返售金融资产	2,599,009.86	-	-	-	-	-	2,599,009.86
应收股利	-	-	-	-	-	525.98	525.98
应收清算款	-	-	-	-	-	1,485.21	1,485.21
其他资产	-	-	-	-	-	29.40	29.40
资产总计	3,821,572.73	-	3,015,789.04	-	-	45,584,961.13	52,422,322.90
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,953.35	23,953.35
应付托管费	-	-	-	-	-	6,397.20	6,397.20
其他负债	-	-	-	-	-	73,924.36	73,924.36
负债总计	-	-	-	-	-	104,274.91	104,274.91
利率敏感度缺口	3,821,572.73	-	3,015,789.04	-	-	45,480,686.22	52,318,047.99
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,998,596.89	-	-	-	-	-	6,998,596.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	31,794,144.32	31,794,144.32
买入返售金融资产	10,003,797.25	-	-	-	-	-	10,003,797.25
应收股利	-	-	-	-	-	756.27	756.27

其他资产	-	-	-	-	-	176.44	176.44
资产总计	17,002,394.14	-	-	-	-	-31,795,077.03	48,797,471.17
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,006.37	16,006.37
应付托管费	-	-	-	-	-	6,646.95	6,646.95
负债总计	-	-	-	-	-	22,653.32	22,653.32
利率敏感度缺口	17,002,394.14	-	-	-	-	-31,772,423.71	48,774,817.85

注：本表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产比例较小。因此，市场利率变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)



交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	45,582,920.54	87.13	31,794,144.32	60.86
交易性金融资产—债券投资	3,015,789.04	5.76	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	48,598,709.58	92.89	31,794,144.32	60.86

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准的公允价值发生变化，其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准的公允价值上升5个百分点	1,129,813.80	-
	业绩比较基准的公允价值下降5个百分点	-1,129,813.80	-

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	45,582,920.54	31,794,144.32
第二层次	3,015,789.04	-
第三层次	-	-
合计	48,598,709.58	31,794,144.32

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	45,582,920.54	86.95
3	固定收益投资	3,015,789.04	5.75
	其中：债券	3,015,789.04	5.75
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,599,009.86	4.96
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	1,211,659.67	2.31
8	其他各项资产	12,943.79	0.02
9	合计	52,422,322.90	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本报告期末，本基金未持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本报告期末，本基金未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末进行股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,015,789.04	5.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,015,789.04	5.76

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019703	23 国债 10	20,000	2,010,526.03	3.84

2	102238	国债 2310	10,000	1,005,263.01	1.92
---	--------	---------	--------	--------------	------

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.12 本报告期投资基金情况

##### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金在控制风险的前提下，依据下滑曲线进行大类资产战略配置和战术调整，追求养老资产的长期稳健增值，力争为投资者提供稳健的养老理财工具。

本基金为混合型目标日期基金中基金 (FOF)，随着目标日期期限的接近，权益类投资比例逐渐下降，风险与收益水平会逐步降低。本基金预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、货币型基金中基金 (FOF)、债券型基金和债券型基金中基金 (FOF)，低于股票型基金和股票型基金中基金 (FOF)。

本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

##### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	000912	英大现	契约	3,593,746.64	3,593,746.64	6.87	是

		金宝货币 A	型开放式				
2	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	750,000.00	2,911,500.00	5.57	否
3	530021	建信纯债债券 A	契约型开放式	1,327,191.06	2,074,532.35	3.97	否
4	004475	华泰柏瑞富利混合 A	契约型开放式	1,040,883.16	2,063,030.42	3.94	否
5	002910	易方达供给改革混合	契约型开放式	752,188.81	2,058,815.99	3.94	否
6	006965	财通安瑞短债债券 A	契约型开放式	1,779,843.27	2,057,676.80	3.93	否
7	003568	平安惠利纯债债券	契约型开放式	1,894,921.24	2,054,284.12	3.93	否
8	002650	东方红稳添利纯债 A	契约型开放式	1,874,778.31	2,051,569.90	3.92	否
9	006804	富国短债债券 A	契约型开放式	1,791,884.16	2,050,811.42	3.92	否
10	110053	易方达安源中短债债券 A	契约型开放式	1,880,825.91	2,050,288.32	3.92	否
11	003767	宏利纯利债券 A	契约型开放式	1,943,048.34	2,048,555.86	3.92	否
12	006646	添富短债债券	契约型开	1,834,680.27	2,044,384.22	3.91	否

		A	放式				
13	519718	交银纯 债债券 发起 A/B	契约 型开 放式	1,839,543.82	2,019,635.16	3.86	否
14	001667	南方转 型增长 灵活配 置混合 A	契约 型开 放式	1,029,842.37	1,988,625.62	3.80	否
15	159915	易方达 创业板 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	910,000.00	1,969,240.00	3.76	否
16	006624	中泰玉 衡价值 优选混 合 A	契约 型开 放式	923,624.81	1,964,457.61	3.75	否
17	510500	南方中 证 500ETF	交易 型开 放式 (ETF)	200,000.00	1,219,000.00	2.33	否
18	518880	华安黄 金易 (ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	230,000.00	1,000,270.00	1.91	否
19	159870	鹏华中 证细分 化工产 业 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,450,000.00	984,550.00	1.88	否
20	588000	华夏上 证科创 板 50 成份 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	930,000.00	978,360.00	1.87	否

21	519002	华安安信消费混合 A	契约型开放式	222,186.97	976,956.11	1.87	否
22	159766	富国中证旅游主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	900,000.00	788,400.00	1.51	否
23	159867	鹏华中证畜牧养殖 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,000,000.00	693,000.00	1.32	否
24	512680	广发中证军工 ETF	交易型开放式 (ETF)	500,000.00	576,000.00	1.10	否
25	516110	国泰中证 800 汽车与零部件 ETF	交易型开放式 (ETF)	520,000.00	543,920.00	1.04	否
26	159611	广发中证全指电力 ETF	交易型开放式 (ETF)	550,000.00	517,000.00	0.99	否
27	512880	国泰中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	560,000.00	492,240.00	0.94	否
28	517180	南方富时中国国企开放共赢 ETF	交易型开放式 (ETF)	360,000.00	484,920.00	0.93	否
29	516160	南方中证新能源 ETF	交易型开放式 (ETF)	550,000.00	483,450.00	0.92	否

30	515030	华夏中证新能源汽车ETF	交易型开放式(ETF)	300,000.00	461,700.00	0.88	否
31	512690	鹏华中证酒ETF	交易型开放式(ETF)	500,000.00	382,000.00	0.73	否

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,903.20
2	应收清算款	1,485.21
3	应收股利	525.98
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	29.40
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,943.79

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
222	235,023.40	51,999,500.00	99.66	175,694.53	0.34

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	90,849.49	0.1741

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	51,999,500.00	99.66	51,999,500.00	99.66	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	90,700.49	0.17	77,492.75	0.15	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	52,090,200.49	99.84	52,076,992.75	99.81	3年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2022 年 11 月 28 日)	52,159,072.03
基金份额总额	52,159,072.03
本报告期期初基金份额总额	52,159,072.03

本报告期基金总申购份额	16,122.50
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	52,175,194.53

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，英大基金管理有限公司于 2023 年 1 月 14 日发布公告，自 2023 年 1 月 13 日起，范育晖代为履行英大基金管理有限公司董事长职务；于 2023 年 4 月 1 日发布公告，自 2023 年 3 月 31 日起，汤戈先生不再担任英大基金管理有限公司权益投资总监（履行高级管理人员职务）。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的基金在报告期内未发生重大影响事件。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更审计的会计师事务所。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
湘财证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，公司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

#### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
湘财证券	3,004,880.00	100.00	344,200,000.00	100.00	-	-	37,577,958.67	100.00

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	英大基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-1-14
2	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-1-19
3	英大基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告	中国证监会规定媒介	2023-2-21

4	关于英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 开放日常申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-2-24
5	英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-2-27
6	英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-13
7	关于英大基金管理有限公司北京分公司经营场所变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-15
8	英大基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-22
9	英大基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-22
10	英大基金管理有限公司关于增加九州证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-29
11	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-3-30
12	英大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-4-1
13	英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-4-21
14	英大基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-4-21
15	英大基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-6-5
16	英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明 (2023 年 6 月)	中国证监会规定媒介	2023-6-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101 - 20230630	51,999,500.00	0.00	0.00	51,999,500.00	99.66

产品特有风险
--------

**(1) 赎回申请延期办理的风险**

持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。

**(2) 基金净值大幅波动的风险**

当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。

**(3) 基金规模较小导致的风险**

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。

**(4) 提前终止基金合同的风险**

极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临终止基金合同等风险。

**(5) 对重大事项进行投票表决时面临的风险**

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。
----

**§ 12 备查文件目录****12.1 备查文件目录**

中国证监会批准英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）设立的文件

《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》

《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》

《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》

《英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）产品资料概要》

基金管理人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

**12.2 存放地点**

基金管理人和基金托管人住所。

**12.3 查阅方式**

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：<http://www.ydamc.com/>

英大基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日